

金融學博士研究生理論性論文範本

摘要

(概述論文選題背景和意義、分析方法、結論、政策建議、貢獻)

第一章 緒論

- 1.1 論文研究背景和意義
- 1.2 研究內容
- 1.3 研究框架
- 1.4 現有文獻的問題與不足
- 1.5 論文結構與創新

第二章 文獻論述與分析

- 2.1 XXX (文獻領域一)
- 2.2 XXX (文獻領域二)

(按照主題分類挑選與論文研究問題相關程度高的文獻、並以從大範圍(相對不相關)到小範圍(直接相關)的順序組織。)

第三章 研究創新點一

- 3.1 現有相關理論模型
- 3.2 創新的理論模型
- 3.3 市場均衡
 - 3.3.1 定義並求解市場均衡(用淺顯易懂的文字分析均衡結果)
 - 3.3.2 比較靜態分析(詮釋變化原因)
- 3.4 量化模擬
 - 3.4.1 模擬過程
 - 3.4.2 校準模型(賦予確定的函數形式和參數值,並明確校準對象的數值)
 - 3.4.3 模擬結果(需對比模擬出的經濟特徵變量數值與現實數據中的數值)
- 3.5 反事實分析(或政策實驗)
 - 3.5.1 實驗目標和過程

3.5.2 分析結果（需對比量化模擬結果和反事實分析中各實驗結果）

3.5.3 機制分析

3.6 穩健性檢驗

3.6.1 情景一（放鬆某假定）

3.6.2 情景二（放鬆某假定）

3.7 結論與政策建議

3.7.1 結論

3.7.2 政策建議

第四章 研究創新點二

（按照第三章 研究創新點一的框架編寫）

第五章 研究創新點三

（按照第三章 研究創新點一的框架編寫）

第六章 創新理論的應用

（綜合以上第三至五章的創新理論模型，再進行數據計量分析）

6.1 綜合創新理論模型

6.2 綜合模型後調整的市場均衡

6.3 量化模擬

6.4. 反事實分析

6.5 穩健性檢驗

6.6 結論與政策建議

第七章 總結與展望

7.1 論文工作總結

7.2 研究展望

7.3 結束語

參考文獻

目 錄

第一章 緒 論.....	1
1.1 論文的研究背景.....	1
1.1.1 國際金融市場快速發展.....	1
1.1.2 計量經濟學在現代經濟學中的重要地位.....	2
1.1.3 金融計量學的發展與金融波動模型.....	3
1.2 問題的提出.....	6
1.2.1 相關係數及傳統分析方法的不足與缺陷.....	6
1.2.2 Copula 理論的研究.....	7
1.2.3 基於 Copula 理論的多變數金融時間序列的相關性分析與建模研究	7
1.2.4 動態 Copula 模型的研究.....	8
1.2.5 Copula 模型在金融市場風險管理上的應用研究.....	9
1.3 論文的結構與創新.....	9
1.3.1 論文的結構.....	9
1.3.2 論文的創新點.....	11
第二章 Copula 理論及其在金融分析上的應用.....	14
2.1 Copula 函數簡介.....	14
2.1.1 Copula 函數的定義和基本性質.....	15
2.1.2 Copula 函數的分類.....	18
2.2 基於 Copula 理論的一致性和相關性測度.....	20
2.2.1 一致性和相關性測度.....	21
2.2.2 尾部相關測度.....	24
2.3 Copula 理論在金融分析上的應用.....	27
2.3.1 多變數時間序列分析.....	28
2.3.2 金融市場的相關性分析.....	29
2.3.3 金融風險管理.....	30
2.4 本章小結.....	31
第三章 基於 Copula 理論的多變數金融時間序列的相關性分析與建模研究 ..	33
3.1 Copula 模型的構建.....	34

3.1.1 金融時間序列的邊緣分佈模型.....	34
3.1.2 Copula 函數與相關性分析.....	42
3.1.3 Copula 模型的構建方法.....	49
3.2 基於 Copula 理論的多變數金融時間序列模型.....	51
3.2.1 多元 Copula-ARCH 類模型.....	52
3.2.2 多元 Copula-SV 類模型.....	57
3.3 Copula 模型的估計和檢驗.....	60
3.3.1 Copula 模型的估計.....	60
3.3.2 Copula 模型的檢驗.....	61
3.4 中國股票市場相關程度與相關模式的實證研究.....	65
3.4.1 Copula 模型的選取.....	66
3.4.2 Copula 模型的估計結果與評價.....	66
3.4.3 中國股票市場相關程度與相關模式的分析.....	69
3.5 本章小結.....	71
第四章 時變相關 Copula 模型的研究.....	73
4.1 時變相關參數演化方程的探討.....	73
4.2 時變相關的二元正態 Copula 模型.....	74
4.3 時變相關的二元 Joe-Clayton Copula 模型.....	76
4.3.1 條件尾部相關係數.....	76
4.3.2 時變相關的二元 Joe-Clayton Copula 模型.....	76
4.4 時變相關 Copula 模型的實證研究.....	78
4.4.1 Copula 模型的選取.....	78
4.4.2 Copula 模型的估計結果與評價.....	79
4.4.3 小結.....	85
4.5 本章小結.....	86
第五章 變結構 Copula 模型的研究.....	87
5.1 Copula 模型變結構問題描述.....	88
5.2 變結構邊緣分佈模型的研究.....	90
5.2.1 分階段建模的波動模型.....	91
5.2.2 變截距波動模型.....	91
5.2.3 具有 Markov 結構轉換機制的變結構波動模型.....	92
5.3 Copula 模型變結構問題的研究.....	95
5.3.1 分階段構建 Copula 模型.....	95

5.3.2 二元正態 Copula 模型變結構點的診斷	97
5.3.3 具有尾部變結構特性的二元 Copula 模型的研究	105
5.3.4 具有變結構邊緣分佈的變結構 Copula 模型的研究	106
5.4 中國股市變結構 Copula 模型的實證研究	113
5.4.1 上海股市的二元正態 Copula 模型變結構點的診斷與分段建模	113
5.4.2 具有尾部變結構特性的二元 Copula 模型的實證研究	120
5.5 本章小結	124
第六章 Copula 模型在金融風險管理上的應用研究	125
6.1 資產投資組合的模擬與投資組合 VaR 的計算	126
6.1.1 資產投資組合的選擇與 VaR 風險模型的選取	126
6.1.2 兩個資產的投資組合的模擬與 VaR 的計算	127
6.1.3 多個資產投資組合模擬與 VaR 的計算	129
6.2 Copula 模型與金融市場的傳染分析	133
6.2.1 金融市場的傳染效應	133
6.2.2 Copula 模型在金融傳染分析上的應用	134
6.3 實證研究	136
6.3.2 Copula 模型的估計結果	136
6.3.3 投資組合的選取及其 VaR 的計算	139
6.4 本章小結	143
第七章 總結與展望	145
7.1 論文工作總結	145
7.1.1 Copula 理論及其應用綜述	145
7.1.2 基於 Copula 理論的多變數金融時間序列的建模研究	146
7.1.3 時變相關 Copula 模型的探討與應用研究	146
7.1.4 變結構 Copula 模型的研究	146
7.1.5 Copula 模型在金融風險管理上的應用研究	147
7.2 研究展望	147
7.2.1 Copula-SV 模型的深入研究及其應用	147
7.2.2 構建 SV-Copula 模型來研究金融市場的杠杆效應	148
7.2.3 多變數和動態 Copula 模型更深入的研究	148
7.2.4 其它值得研究的問題	148
7.3 結束語	149

參考文獻.....	150
攻讀博士期間發表論文與參加科研專案情況.....	164
致 謝.....	165